



Durée de la formation ?

2 jours.

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires impliqués de près ou de loin dans le calcul du SCR. Aux gestionnaires des risques, et en particulier du risque opérationnel. Aux réassureurs désireux de se familiariser avec les techniques du risque opérationnel.

Pour obtenir quoi ?

Créer et gérer une base incident compatible avec les bases de marché. Maîtriser diverses méthodes de mesure du risque opérationnel, et tarifier la couverture de celui-ci.

Comment ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, par des travaux pratiques d'application réalisés sous « R », logiciel libre qui sera fourni aux participants.

Quels sont les prérequis ?

Connaissances générales en statistique.

Qu'allez-vous apprendre ?

Introduction

- La gestion du risque : principes fondamentaux

Le risque opérationnel : identification et gestion

- Cadre réglementaire
- Définition et enjeux
- Système DMCGD

Base incidents

- Enjeux de la collecte des incidents
- Compréhension des données et du processus de collecte
- Construction d'une base des incidents

Quantification du risque opérationnel

- Formule standard, USP et modèle interne partiel
- Tarification : approche prospective VS approche rétrospective
- Méthode rétrospective : sinistres attritionnels et graves, traitement
- Exemple d'application

Modélisation du risque opérationnel

- Internal Measurement Approach (IMA) et Loss Distribution Approach (LDA)
- LDA, technique bayésienne
- Prise en compte d'un seuil de collecte dans la tarification
- Intégration d'avis d'expert et exercice d'application
- Polya tree et application
- Extension par crédibilité, application
- Courbes ROC et interprétations

Comparaison des méthodes

- Avantages et limites
- Cohérence
- Conclusion générale

Qui anime cette formation ?

Xavier MILHAUD,

Actuaire certifié et Maître de Conférences associé à l'ISFA Lyon, Membre de l'Institut des Actuaires et Ingénieur en Informatique et Mathématiques Appliquées.



La formation en pratique...

Quand et où ?

2 et 3 novembre 2020

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8°

Combien ça coûte ?

2 100 € HT + TVA 20%, soit 2 520 € TTC.

Les frais de participation couvrent les deux journées de formation, la documentation complète, les deux déjeuners et les pauses café.

Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :

Elysées West Hôtel - 01 85 34 72 00

Précisez que vous venez de la part de Caritat.

<http://elysees.hotusa.com/caritat/>

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

! Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

Qu'en disent les stagiaires ?

« Les exposés sont clairs. Les documents sont bien élaborés. Les exemples d'application sont très pratiques. Le formateur a une bonne approche pédagogique. »

AD, Statisticien - CICA RE